

NEWSLETTER

Excel Reporting

ePOCA Mandant
Referenzwährung CHF
Per 31.12.2012

Quervergleich der Performance

Anlagekategorie	Portfolio	Benchmark	Performance				Anlagevermögen				
			Letzter Monat		Letztes Quartal		YTD		Effektiv	Strategie	
			Portfolio	Benchmark	Portfolio	Benchmark	Portfolio	Benchmark	Mio CHF	%	%
Liquidität gesamt	Portfolio 1	BM LIQ CHF (3 MT GM CITI)	0.07	-0.01	-0.32	-0.04	0.22	-0.05	22 088 572.67	13.21	5.00
	Portfolio 2	BM LIQ CHF (3 MT GM CITI)	0.02	-0.01	-0.07	-0.04	0.37	-0.05	3 460 140.12	2.07	5.00
	Portfolio 3	BM LIQ CHF (3 MT GM CITI)	0.07	-0.01	0.06	-0.04	0.37	-0.05	9 413 933.81	5.63	5.00
	Portfolio 4	BM LIQ CHF (3 MT GM CITI)	0.20	-0.01	-0.58	-0.04	1.28	-0.05	4 103 592.62	2.45	5.00
	Portfolio 5	BM LIQ CHF (3 MT GM CITI)	-0.07	-0.01	-0.62	-0.04	-0.07	-0.05	3 930 970.22	2.35	5.00
	Portfolio 6	BM LIQ CHF (3 MT GM CITI)	0.22	-0.01	-0.62	-0.04	0.03	-0.05	1 155 152.24	0.69	5.00
Obligationen CHF	Portfolio 1	BM OBLIGATIONEN SCHWEIZ (0.11	-0.10	0.48	0.39	3.83	4.21	24 783.64	0.01	5.00
	Portfolio 2	BM OBLIGATIONEN SCHWEIZ (0.13	-0.10	0.47	0.39	4.54	4.21	13 207 476.55	7.90	32.00
	Portfolio 3	BM OBLIGATIONEN SCHWEIZ (0.20	-0.10	0.69	0.39	5.45	4.21	11 819 164.22	7.07	32.00
Obligationen FW	Portfolio 4	BM OBLIGATIONEN SCHWEIZ (0.04	-0.10	0.37	0.38	2.48	4.21	17 853 245.55	6.48	32.00
	Portfolio 5										
	Portfolio 7										
	Portfolio 1										
	Portfolio 2										
	Portfolio 3										
	Portfolio 4										
Aktien Schweiz	Portfolio 1										
	Portfolio 2										
	Portfolio 3										
	Portfolio 4										
	Portfolio 5										
Aktien Ausland	Portfolio 1										
	Portfolio 2										
	Portfolio 3										
	Portfolio 4										
	Portfolio 5										
Immobilien Schweiz	Portfolio 1										
	Portfolio 2										

ePOCA Mandant
Referenzwährung CHF
Per 31.12.2012

Performance Attribution

Anlagekategorie	Anlage		Performance			Portfolio Contribut.	Benchmark Contribut.	Excess Return	Attribution		
	effektiv	Strategie	effektiv	Benchmark	MWR				Allocation	Selection	Interaction
Liquidität gesamt	14.02	5.00	0.22	-0.05	0.35	0.04	0.00	0.05	0.00	0.01	0.04
Obligationen CHF	28.98	32.00	3.83	4.21	3.76	1.11	1.36	-0.26	-0.14	-0.12	0.01
Obligationen FW	4.43	3.00	3.98	-1.11	3.97	0.17	-0.02	0.19	0.01	0.14	0.04
Aktien Schweiz	12.73	13.00	18.10	17.72	18.21	2.19	2.22	-0.03	-0.07	0.05	0.00
Aktien Ausland	11.12	15.00	11.65	13.37	11.56	1.25	1.99	-0.74	-0.56	-0.18	0.01
Immobilien Schweiz	11.41	12.00	6.72	4.00	6.75	0.76	0.48	0.29	-0.02	0.33	-0.02
Immobilien Ausland	3.03	5.00	5.99	4.43	5.67	0.17	0.22	-0.05	-0.09	0.08	-0.04
Alternative Anlagen	10.23	15.00	0.02	1.18	-1.68	-0.12	0.24	-0.38	-0.27	-0.16	0.05
Kapitalschutz	4.04	0.00	1.45	0.00	1.64	0.07	0.00	0.07	0.00	0.00	0.07
Devisentermingeschäfte	13.80	10.00	1.08	1.07	1.10	0.11	0.12	-0.01	0.02	0.00	-0.03
Total	100.00	100.00	5.76	6.62	5.74	5.75	6.62	-0.86	-1.14	0.16	0.13

Seit einigen Jahren verfügt ePOCA über ein « MS Office » Reporting, welches erlaubt Finanz-Reports oder Investment Reports in MS Word zu generieren. Beispiele solcher Reports sind auf unserer Webseite aufgelistet. Diese ePOCA-Funktion genießt einen grossen Erfolg, da sie ohne Zusatzaufwand qualitative hochwertige Reports aus den Buchhaltungsdaten erzeugt.

Technologie

Die Funktionsweise dieser Reports ist sehr simpel: ePOCA exportiert die notwendigen Daten für den Report ohne sich um dessen Formatierung zu kümmern. Die Formatierung ist in einer Vorlage als herkömmliches MS Word Dokument definiert. Auf diese Weise können Vorlagen in MS Word erstellt werden, ohne dass man sich spezifische Kenntnisse von Reportingtools aneignen muss.

Es ist allerdings nicht nötig die Vorlagen selbst zu schreiben: ePOCA verfügt über eine Sammlung von über hundert Vorlagen, welche die Nachfrage der meisten unserer Kunden abdeckt. Es ist dennoch möglich personalisierte Vorlagen zu entwickeln, die im Einklang zum «corporate identity» der Firma stehen. Viele unserer Kunden, die im Dienstleistungssektor tätig sind, haben bereits von dieser Möglichkeit profitiert und bieten ihren Kunden auf inhaltlicher sowie ästhetischer Ebene personalisierte Reports aus ePOCA an.

Wir haben nun für das Erzeugen von Reports in MS Excel eine ähnliche Technologie entwickelt. Auch in diesem Fall liefert ePOCA die notwendigen Daten und die Formatierung wird in einer separaten Vorlage gespeichert. Zwei Beispiele solcher Reports sehen sie oben, der «Quervergleich der Performance» und die «Performance Attribution»:



Der Performance Attribution Report stellt die klassischen Werte dieses Reports dar: Performance (TWR) der Investition und des Benchmarks, Beitrag zur Performance und relativen Performance (« excess return »), welche in ihre Komponenten, die Allokation, die Selektion und die Interaktion, geteilt wird. Eine zusätzliche Kolonne gibt Auskunft über die MWR Performance der Investition, was Unterschiede zur TWR Performance hervorhebt, die aus grösseren Kapitalflüssen resultieren können.



Der Report «Quervergleich der Performance» zeigt für jede Anlageklasse, z.B. die Schweizer Aktien, die Performance der Portfolios für den letzten Monat, das letzte Quartal und das laufende Jahr. Die Performance des entsprechenden Benchmarks ist auch gegeben. Dieser Report ermöglicht also, die verschiedenen Mandate für jede Anlageklasse miteinander zu vergleichen, selbst gemischte Mandate.

Vorteile / Nachteile

Was sind die Vor- und Nachteile eines MS Excel Reports und eines MS Word Reports

Report in MS Word		Report in MS Excel	
-	Durch das Format des Blattes (normalerweise A4) eingeschränkt.	+	Unlimitierte Breite, kann alle gewünschten Kolonnen enthalten.
-	Zahlen sind als Text formatiert.	+	Zahlen sind wirklich Zahlen.
-	Der Report kann nur mit Text ergänzt werden.	+	Der Report kann mit Text und Formeln ergänzt werden.
+	Der Report enthält alle seine Bestandteile in einem einzigen Dokument, inklusive Titelblatt und Inhaltsverzeichnis.	-	Der ganze Rapport besteht aus mehreren Dateien oder einer Datei mit mehreren Arbeitsblättern.
+	Der Rapport kann direkt gedruckt werden.	-	Der ausgedruckte Report ist nicht unbedingt leicht zu lesen (kleine Zeichen oder Tabelle auf mehreren Seiten).

Wie die Tabelle oben aufzeigt, ist das Reporting mit MS Excel nicht ein Ersatz, sondern ein Zusatz zum Reporting mit MS Word. Haben wir ihr Interesse geweckt? Bitte kontaktieren Sie uns für einen Termin.

Ihr C&H Team

ePOCA® - die führende Software für die Wertschriftenbuchhaltung und Investment Reporting. Mehr Informationen zu ePOCA erhalten sie unter: www.chsoft.ch



Freudenbergstrasse 142
8044 Zürich
epoca@chsoft.ch
Tel. +41 44 366 66 66